

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 27 de julio de 2023
Fecha de Información: 25 de julio de 2023¹

Según el reporte de los Sistemas de Información y Registro de Operaciones sobre Divisas del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$5502 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 11.25%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragruppo y Off-shore ^c		Otros Agentes		Intermediarios del Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	1195,8	782,0	414,6	853,0	70,9	46,3	296,5
15-35	792,6	805,8	470,6	324,8	28,5	161,1	306,7
36-60	169,2	1095,0	1028,2	2,9	46,8	146,3	20,0
61-90	70,3	159,8	149,2	70,0	10,6	0,3	0,0
91-180	272,7	66,9	20,0	254,6	31,9	3,1	15,0
>180	676,9	52,9	35,0	670,6	17,9	6,4	0,0
Total	3177,6	2962,5	2117,7	2175,9	206,6	363,5	638,2

^a Cifras en millones de dólares

^b Incluye operaciones entre Intermediarios del Mercado Cambiario y operaciones con los otros agentes

^c Operaciones entre filiales (casas matrices y filiales) y con entidades del exterior

Cuadro No. 2 Devaluación Implícita Ponderada por monto Anualizada

Rango	Intermediarios del Mercado Cambiario ^a		Otros Agentes sin intragrupo		Total
	Compras/Ventas		Compras	Ventas	
3-14	12.09%		11.53%	10.46%	11.30%
15-35	12.01%		11.96%	12.09%	12.01%
36-60	12.26%		11.72%	9.19%	10.03%
61-90	-		10.34%	10.62%	10.58%
91-180	9.90%		9.31%	9.91%	9.58%
>180	-		8.08%	7.57%	7.91%
Total	12.01%		11.34%	10.60%	11.25%

^a Incluye solo operaciones entre Intermediarios del Mercado Cambiario

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.

¹A partir del 7 de diciembre se calcula este reporte incorporando la información preliminar reportada por los Sistemas de Información y Registro de Operaciones sobre divisas al Banco de la República.

²El monto negociado diario corresponde a las operaciones de compra y venta evitando la doble contabilización de las operaciones interbancarias. Además, la fórmula para la devaluación implícita es: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado})^{(365/\text{Plazo})}) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

“Cuadro No. 3 Vencimientos de Forwards

Sectores	24 – 28 jul.				31 jul. - 04 ago.				07 - 11 ago.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	61	300	7823	7900	28	206	5262	6981	13	150	3744	3863
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	3318	3592	0	0	4716	3024	0	0	2463	2205
Otros ^c	300	61	2213	1856	206	28	591	564	150	13	310	407
Total	361	361	13354	13348	234	234	10569	10569	163	163	6517	6475

^a Cifras en millones de dólares.

^b Incluye operaciones entre Intermediarios del Mercado Cambiario y otros agentes

^c Operaciones entre filiales (casas matrices y filiales) y con entidades del exterior.